

DAFTAR ISI

JUDUL PENELITIAN	i
ABSTRAK	iii
LEMBAR PENGESAHAN	v
PERNYATAAN ORISINALITAS	vi
KATA PENGANTAR	vii
DAFTAR ISI	ix
DAFTAR LAMPIRAN	xi
DAFTAR TABEL	xii
DAFTAR GAMBAR	xiii
BAB I PENDAHULUAN	
A. Latar Belakang Masalah.....	1
B. Identifikasi Masalah.....	8
C. Pembatasan Masalah.....	9
D. Perumusan Masalah.....	9
E. Kegunaan Penelitian.....	10
BAB II KAJIAN TEORITIK	
A. Deskripsi Konseptual.....	11
1. Konsep <i>Abnormal Return</i>	11
a. Definisi Efisiensi Pasar Modal.....	11
b. Bentuk-Bentuk Efisiensi Pasar Modal.....	13
c. Alasan-Alasan Pasar yang Efisien dan Tidak Efisien...	15
d. Definisi <i>Abnormal Return</i>	16
e. Jenis-Jenis <i>Abnormal Return</i>	21
2. Kosep <i>Right Issue</i>	22
a. <i>Corporate Action</i>	22
b. Jenis-Jenis <i>Corporate Action</i>	23
c. Definisi <i>Right Issue</i>	23
d. Tujuan <i>Right Issue</i>	28
e. Kinerja Saham <i>Right Issue</i>	29
f. Beberapa Hal yang Berkaitan dengan <i>Right Issue</i>	30
g. Tindakan Investor terhadap <i>Right Issue</i>	32
B. Hasil Penelitian yang Relevan.....	33
C. Kerangka Teoritik.....	35
D. Perumusan Hipotesis.....	37
BAB III METODOLOGI PENELITIAN	
A. Tujuan Peneltian	38
B. Waktu dan Tempat Penelitian.....	38
C. Metode Penelitian.....	38
D. Populasi dan Teknik Pengambilam Sampel.....	40

E. Teknik Pengumpulan Data.....	41
1. <i>Right Issue</i>	41
a. Definisi Konseptual.....	41
b. Definisi Operasional.....	42
2. <i>Abnormal Return</i>	42
a. Definisi Konseptual.....	42
b. Definisi Operasional.....	43
F. Teknik Analisis Data.....	46
1. Uji Persyaratan Analisis.....	46
a. Uji Normalitas Data.....	46
b. Uji Homogenitas.....	47
2. Uji Hipotesis.....	48
G. Hipotesis Statistika.....	50
 BAB IV HASIL PENELITIAN DAN PEMBAHASAN	
A. Deskripsi Data.....	51
B. Pengujian Hipotesis.....	58
1. Uji Persyaratan Analisis.....	58
a. Uji Normalitas.....	58
b. Uji Homogenitas.....	59
2. Uji <i>Paired Sampel T Test</i>	59
C. Pembahasan.....	60
 BAB V KESIMPULAN, IMPLIKASI DAN SARAN	
A. Kesimpulan.....	66
B. Implikasi	67
C. Saran	68
 DAFTAR PUSTAKA.....	70
LAMPIRAN	72
RIWAYAT HIDUP	115

DAFTAR LAMPIRAN

Lampiran	Judul	Halaman
1	Perusahaan yang Melakukan <i>Right Issue</i>	73
2	Perhitungan <i>Actual Return</i>	74
3	Perhitungan Alpha dan Beta Saham.....	79
4	Perhitungan <i>Expected Return</i>	93
5	Perhitungan <i>Abnormal Return</i>	103
6	Perhitungan <i>Average Abnormal Return (AAR)</i>	108
7	Uji Normalitas	109
7	Uji Homogenitas.....	111
9	Uji <i>Paired Sampel T Test</i>	112
10	Surat Permohonan Ijin Penelitian.....	113
11	Surat Penelitian dan Survei BEI.....	114

DAFTAR TABEL

Tabel	Judul	Halaman
I.1	<i>Return</i> Harian Rata-Rata dan <i>Abnormal Return</i> Rata-Rata.....	4
I.2	<i>Return Actual</i> PT.NISP.....	5
II.1	Penelitian Terdahulu.....	33
III.1	Kriteria Populasi Terjangkau.....	40
IV.1	Statistik Deskriptif.....	52

DAFTAR GAMBAR

Gambar	Judul	Halaman
I.1	Pergerakan Harga Saham Selama <i>Right Issue</i>	7
III.1	Gambar Jendela Peristiwa (<i>event window</i>).....	39
IV.1	Pergerakan <i>Abnormal Return</i> di Sekitar Peristiwa	57